

Analisi Predittiva

CT0429
Primo appello

Gennaio, 2022

Cognome: _____ Nome: _____

Matricola: _____ Firma: _____

ISTRUZIONI (DA LEGGERE ATTENTAMENTE).

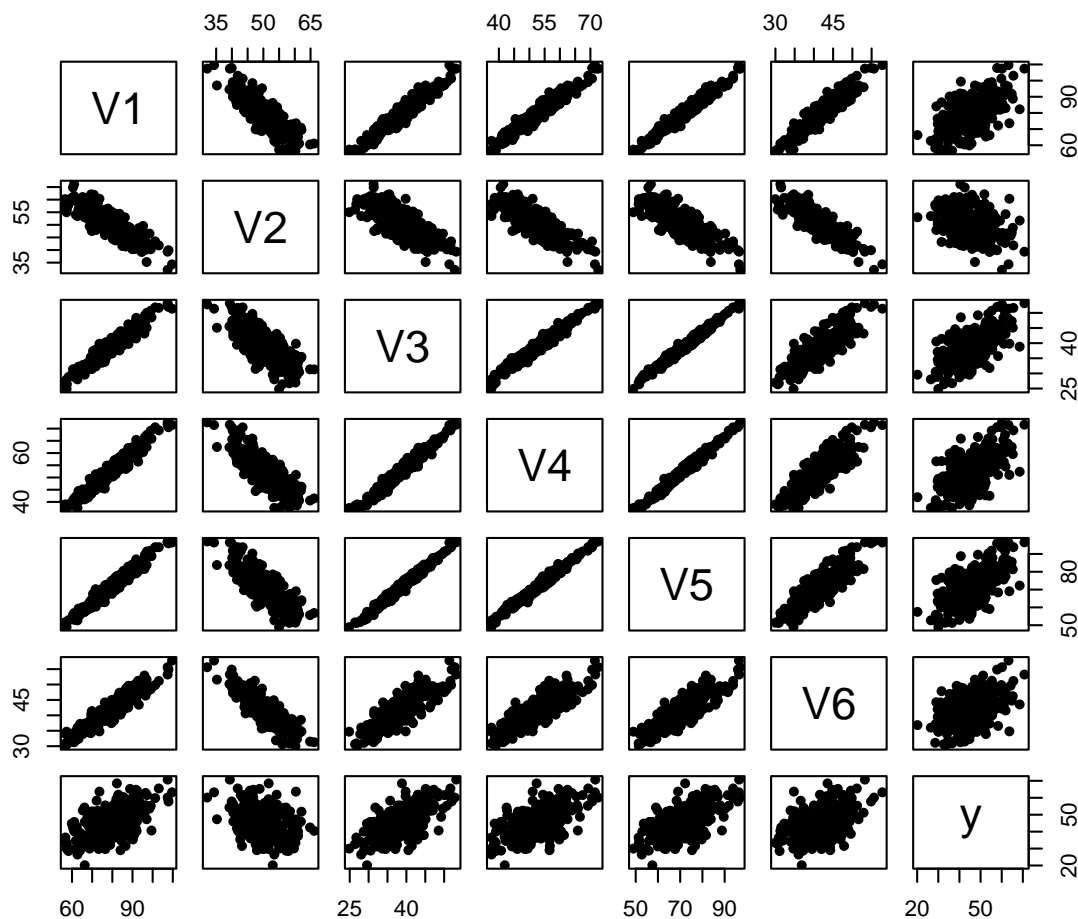
Assicuratevi di aver scritto nome cognome e matricola sia qui che sul file Rmarkdown disponibile su Moodle. Il tempo a disposizione per completare tutto l'esame (la parte scritta e la parte su Moodle) è di **90 minuti**.

Nessuno studente può lasciare l'aula fino a che la docente non avrà verificato che tutti abbiano consegnato sia il compito scritto che il file Rmarkdown. Dopo la consegna attendete che la docente dia il permesso di lasciare l'aula.

Question 1 (4 points)

Si prenda in considerazione il dataset `df`: i grafici di dispersione per le variabili nel dataset sono mostrati nella figura sottostante. Si desidera predire la variabile `y` usando come predittori le variabili `V1`, `V2`, `V3`, `V4`, `V5`, `V6`.

```
plot(df, pch = 16)
```



Per costruire un modello di regressione multiplo un'analista utilizza in prima istanza un modello (chiamato `fitAll`) in cui tutti i predittori sono inseriti come variabili esplicative. Inoltre stima anche un modello `fitV4` in cui solo la variabile `V4` viene usata come predittore. Informazioni riassuntive sulla stima dei due modelli sono mostrati nella pagina successiva.

```
fitAll <- lm(y~., data = df)
summary(fitAll)
```

Call:

```
lm(formula = y ~ ., data = df)
```

Residuals:

	Min	1Q	Median	3Q	Max
	-18.1723	-4.0940	0.0372	4.1096	21.4763

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
(Intercept)	-50.8604	14.3392	-3.547	0.000454 ***
V1	-0.4226	0.3567	-1.185	0.236994
V2	0.6375	0.1553	4.106	5.23e-05 ***
V3	0.2563	0.6587	0.389	0.697434
V4	-0.3347	0.4459	-0.750	0.453561
V5	1.3583	0.5456	2.489	0.013351 *
V6	0.2098	0.3580	0.586	0.558244

Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

Residual standard error: 6.211 on 293 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.4878, Adjusted R-squared: 0.4773

F-statistic: 46.5 on 6 and 293 DF, p-value: < 2.2e-16

```
fitV4 <- lm(y~V4, data = df)
summary(fitV4)
```

Call:

```
lm(formula = y ~ V4, data = df)
```

Residuals:

	Min	1Q	Median	3Q	Max
	-19.5657	-4.6950	-0.5004	4.7360	23.0933

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
(Intercept)	5.72954	3.04571	1.881	0.0609 .
V4	0.75756	0.05723	13.238	<2e-16 ***

Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

Residual standard error: 6.828 on 298 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.3703, Adjusted R-squared: 0.3682

F-statistic: 175.2 on 1 and 298 DF, p-value: < 2.2e-16

- (i) Qual è il valore di R^2 del modello per il modello `fitAll`? Come si può interpretare il valore di R^2 per questo modello?

Nel modello `fitAll` il valore di R^2 è di 0.4878.

Circa il 48.78% della varianza osservata nei dati è spiegata dalla combinazione lineare dei predittori V1,V2,V3,V4,V5,V6, ovvero che il modello `fitAll` riesce a catturare circa il 48.78% della variabilità osservata nei dati.

- (ii) Come si può interpretare il valore del coefficiente angolare relativo alla variabile V4 nei due modelli stimati?

Il coefficiente angolare relativo alla variabile V4 cambia interpretazione a seconda del modello stimato:

1. Nel modello `fitV4`, V4 detta la forza della relazione lineare tra il predittore V4 e la variabile risposta. Il coefficiente stimato viene interpretato come la differenza stimata (in media) della variabile risposta (in unità della variabile risposta), tra due osservazioni le quali differiscono di un'unità di misura del predittore V4. Al crescere di un'unità di misura di V4, la variabile risposta aumenta di circa 0.76 unità di misura.
2. Nel modello `fitAll`, invece, V4 viene interpretato come la differenza stimata (in media) della variabile risposta, tra due osservazioni le quali differiscono di un'unità di misura del predittore V4, assumendo che il resto dei predittori abbiano dei valori fissati. Al crescere di un'unità di misura di V4, in media, la variabile risposta diminuisce di circa -0.3347 unità di misura (a patto che gli altri predittori abbiano valori fissati).

- (iii) In calce sono indicati dei valori di Variance Inflation Factors (VIFs) per dei modelli stimati. Quale delle due opzioni è più probabile corrisponda ai VIFs per il modello `fitAll` stimato usando i dati mostrati nella Figura? Opzione 1

Opzione 1:

```
car::vif(fitAll)
```

V1	V2	V3	V4	V5	V6
94.303945	5.439288	87.504215	73.386967	188.780574	22.216378

Opzione 2:

```
car::vif(fitAll)
```

V1	V2	V3	V4	V5	V6
1.025082	1.018174	1.006091	1.046011	1.049240	1.022209

Considerando che
1) Ci sono delle variabili che sono estremamente correlate fra loro [Vedi immagine dei pairplot]
2) I p-value sono poco significativi e l'impatto delle stime pure dato che sono tutte vicine allo 0

Ci sono delle variabili che sono estremamente correlate fra loro e ne consegue che probabilmente i predittori stiano "rubandosi" a vicenda il poter predittivo.

Question 2 (3 points)

Il gestore di un chiosco di gelati desidera studiare la relazione tra il numero di auto parcheggiate in una giornata nel parcheggio della spiaggia dove è posizionato il chiosco e il fatturato giornaliero (in decine di euro). Le informazioni disponibili al gestore sono salvate nel dataframe `df`. Le seguenti informazioni riassuntive sul dataset sono disponibili:

```
summary(df)
```

```
      numAuto      fatturato
Min.   : 29.0   Min.   : 22.6
1st Qu.:150.2   1st Qu.:112.8
Median :217.5   Median :164.8
Mean   :222.7   Mean   :166.7
3rd Qu.:282.8   3rd Qu.:207.5
Max.   :636.0   Max.   :423.5
```

Inoltre, il gestore stima il seguente modello predittivo per il fatturato:

```
fit <- lm(fatturato ~ numAuto, data = df)
```

```
summary(fit)
```

Call:

```
lm(formula = fatturato ~ numAuto, data = df)
```

Residuals:

```
      Min       1Q   Median       3Q      Max
-51.5   -11.8     0.4    13.1    38.8
```

Coefficients:

```
              Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
(Intercept)   17.810      5.954      3    0.004 **
numAuto         0.669      0.024     28   <2e-16 ***
---

```

Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

Residual standard error: 19 on 58 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.93, Adjusted R-squared: 0.93

F-statistic: 7.6e+02 on 1 and 58 DF, p-value: <2e-16

```
confint(fit)
```

```
              2.5 %      97.5 %
(Intercept) 5.890551 29.7289948
numAuto      0.6202373 0.7176025
```

Il gestore desidera verificare l'evidenza contro l'ipotesi nulla che β_1 (il coefficiente angolare che descrive l'effetto di `numAuto` sul fatturato) abbia valore pari a 0.6, cioè vuole condurre un test di verifica di ipotesi per il sistema di ipotesi:

$$H_0 : \beta_1 = 0.6 \quad VS \quad H_1 : \beta_1 \neq 0.6$$

Il gestore desidera infine predire il fatturato per una giornata in cui sono presenti 300 auto nel parcheggio:

```
nd <- data.frame(numAuto = 300)
```

```
predict(fit, newdata = nd)
```

```
[1] NA
```

- (i) Si derivi il valore della statistica test per il sistema di verifica di ipotesi specificato nel testo

$$TS = EST-HYP/SE = 0.669-0.6/0.024 = 2.875$$

- (ii) Si indichi se è possibile o meno rigettare l'ipotesi nulla del sistema di verifica di ipotesi specificato nel testo (al livello di significatività del 5%)

Dal risultato di `confint(fit)`, che rappresenta l'intervallo di confidenza per i parametri stimati al livello di significatività del 5%, vediamo che il valore HYP = 0.6 è fuori dall'intervallo.

Inoltre, calcolando il p-value per la statistica test TS, ci accorgiamo che esso è molto significativo.

$$2 * pt(abs(2.875), df=58, lower.tail = FALSE) = 0.005640675$$

Possiamo dunque rifiutare l'ipotesi nulla che $\beta_1=0.6$ al livello di significatività del 5%

- (iii) Si indichi il valore stimato del fatturato (in decine di euro) per una giornata in cui 300 auto sono presenti nel parcheggio (si indichi cioè il valore mancante dell'output di `predict`)

Il valore stimato (o stima puntuale) è rappresentato come $E[\text{fatturato} | \text{numAuto} = 300]$

$$E[\text{fatturato} | \text{numAuto} = 300] = \beta_0 + \beta_1 * 300 = 17.810 + (0.669 * 300) = 208.51$$

Question 3 (3 points)

Si prenda in considerazione il seguente modello stimato usando il dataset `df` mostrato nel codice sottostante:

```
fit <- lm(y ~ x1+x2+x1:x2, data = df); coef(fit)
```

(Intercept)	x1	x2b	x1:x2b
26.66667	22.00000	397.33333	-81.00000


```
df
```

	x1	x2	y
1	1	a	45
2	2	a	78
3	3	a	89
4	4	b	188
5	5	b	129

- (i) Si dia l'espressione della matrice di disegno X usata nella stima del modello (quello cioè che si otterrebbe usando `model.matrix(fit)`).

```
data <- data.frame(x1=c(1,2,3,4,5), x2=c("a","a","a","b","b"), y=c(45,78,89,188,129))
```

```
fit <- lm(y ~ x1+x2+x1:x2, data = data)
```

```
model.matrix(fit)
```

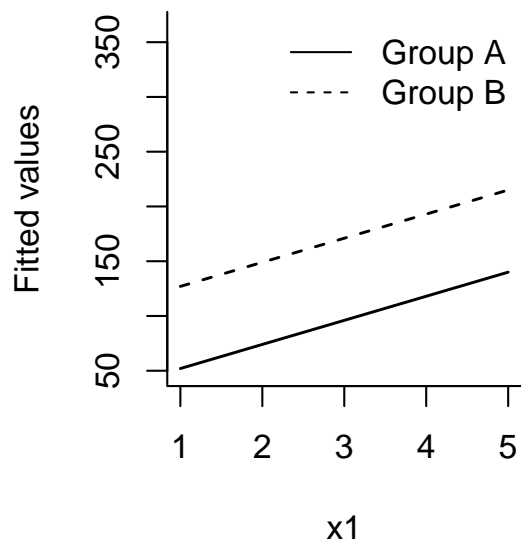
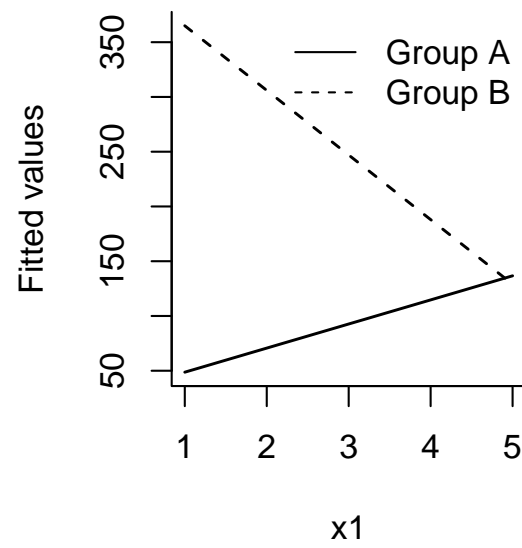
(Intercept)	x1	x2b	x1:x2b	
1	1	0	0	= X
1	2	0	0	
1	3	0	0	
1	4	1	4	
1	5	1	5	

- (ii) La Figura nella pagina successiva mostra la relazione stimata tra $x1$ e y per i due gruppi A e B (l'informazione del gruppo di appartenenza per ogni osservazione è specificata nella variabile $x2$). In quale dei due pannelli è più probabile che sia mostrata la relazione stimata dal modello `fit`? Pannello 2

```
> predict(fit,newdata=data.frame(x1=2,x2="b"))
```

[1] 306

Il pannello due include l'interazione tra $x1$ ed $x2$, perciò avremo 2 coefficienti angolari e due intercette diverse (abbiamo una variabile categoriale ed un'interazione). Possiamo confermare ciò con una veloce stima di un punto teorico per vedere che le rette stimate dal modello sono rappresentate proprio nel pannello due

Pannello 1**Pannello 2**

Question 4 (5 points)

Il gestore di un chiosco di gelati desidera studiare la relazione tra il numero di di gelati venduti tra le 14 e le 18 di una giornata e alcuni potenziali predittori: la temperatura della giornata, l'informazione se la giornata è un giorno festivo, il numero di auto presenti nel parcheggio della spiaggia dove è posizionato il chiosco.

Stima quindi tre diversi modelli per cui sono fornite alcune informazioni sintetiche:

```
fit1 <- glm(numGelati ~ numAuto+festivo, data = df, family = poisson)
fit2 <- glm(numGelati ~ numAuto+temperatura, data = df, family = poisson)
fitAll <- glm(numGelati ~ numAuto+temperatura+festivo,
              data = df, family = poisson)

deviance(fit1); deviance(fit2); deviance(fitAll)

[1] 293.5679

[1] 94.42806

[1] 68.08272

logLik(fit1); logLik(fit2); logLik(fitAll)

'log Lik.' -217.192 (df=3)

'log Lik.' -117.6221 (df=3)

'log Lik.' -104.4494 (df=4)

coef(fit1)

      (Intercept)      numAuto festivo festivo
           1.50           2.00           0.24

nd <- data.frame(numAuto = 100, festivo = "feriale", temperatura = 25)

predict(fit, newdata = nd, type = "response")

[1] NA
```

- (i) Usando il modello `fit1` si stimi il numero di gelati venduti in una giornata feriale in cui 100 auto sono presenti nel parcheggio e la temperatura è di 25 gradi (si indichi cioè il valore mancante dell'output di `predict`)
- (ii) Quale modello tra i tre stimati raggiunge un valore di AIC minore?
- (iii) Come è possibile confrontare la bontà di adattamento dei modelli `fit1` e `fit2`? E se invece si desidera confrontare la bontà di adattamento dei modelli `fit1` e `fitA11`? (non è necessario confrontare effettivamente i modelli, basta descrivere come sarebbe possibile confrontarli).

Question 5 (3 points)

In un sito di e-commerce viene monitorato se per una determinata transazione viene esercitata l'opzione di reso: questa informazione è salvata nella variabile `reso`, che ha valore 1 se per la transazione è stata esercitata l'opzione di reso. Un primo modello predittivo mira a verificare se l'ammontare totale del costo della transazione (variabile `totalSpent`) influisce sulla probabilità che venga attivata l'opzione di reso:

```
fit1 <- glm(reso ~ totalSpent, data = df, family = binomial())
coef(fit1)
```

```
(Intercept)  totalSpent
-7.60140758  0.03365754
```

Viene poi stimato un altro modello in cui come predittori vengono anche inserite delle variabili che indicano il numero totale di pezzi nell'ordine (`totalPieces`) e l'informazione se la consegna dell'ordine è avvenuta in ritardo (`isDelayed`):

```
fit2 <- glm(reso ~ totalSpent+totalPieces+isDelayed,
            data = df, family = binomial())
```

I due modelli vengono poi confrontati tramite un test `anova`:

```
anova(fit1, fit2, test = "LRT")
```

Analysis of Deviance Table

```
Model 1: reso ~ totalSpent
Model 2: reso ~ totalSpent + totalPieces + isDelayed
  Resid. Df Resid. Dev Df Deviance Pr(>Chi)
1      148      66.619
2      146      65.354  2    1.2651  0.5312
```

- (i) La Figura nella pagina successiva mostra la relazione stimata tra `totalSpent` e la probabilità che per la transazione venga attivato un reso (cioè $P(\text{reso} = 1)$). In quale dei tre pannelli è più probabile che sia mostrata la relazione stimata dal modello `fit1`? Pannello _____
- (ii) Cosa possiamo evincere dal test `anova` in cui vengono messi a confronto i modelli `fit1` e `fit2`?

